

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 13 de septiembre de 2022
Fecha de Información: 09 de septiembre de 2022¹

Según el reporte de los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre Divisas del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$3479 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.42%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

Rango	Sector Financiero ^b		Intragrupo y Off-shore ^c		Otros Agentes		Intermediarios del
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Mercado Cambiario
3-14	920,4	1165,3	335,1	423,7	357,2	23,7	473,0
15-35	945,1	1058,8	457,7	295,4	70,0	0,0	649,7
36-60	2,3	25,5	0,0	0,0	25,5	2,3	0,0
61-90	189,8	87,9	32,6	0,0	30,4	164,8	25,0
91-180	116,2	99,3	22,0	80,0	42,3	1,2	35,0
>180	31,4	38,1	10,0	6,5	9,1	5,9	19,0
Total	2205,2	2475,1	857,4	805,6	534,5	197,9	1201,7

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Intermediarios del Mercado Cambiario ^a		Otros Agentes sin intragrupo		
	Compras/Ventas		Compras	Ventas	Total
3-14	6.76%		5.44%	5.51%	5.93%
15-35	6.76%		6.46%	6.74%	6.64%
36-60	—		7.16%	6.92%	7.14%
61-90	7.06%		6.94%	6.86%	6.89%
91-180	7.42%		7.60%	7.48%	7.52%
>180	7.61%		7.79%	7.66%	7.66%
Total	6.80%		6.12%	6.37%	6.42%

^a Incluye solo operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹A partir del 7 de diciembre se calcula este reporte incorporando la información preliminar reportada por los Sistemas de Información y Registro de Operaciones sobre divisas al Banco de la República.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

Sectores	05 – 09 sep.				12 - 16 sep.				19 - 23 sep.			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero ^a	7	39	576	644	64	210	6588	8318	18	188	8352	8286
Intragrupo y off-shore ^b	0	0	402	400	1	0	3076	2420	0	0	4205	3619
Otros ^c	39	7	165	92	209	64	2569	1199	188	18	1242	1858
Total	46	46	1143	1136	274	274	12233	11937	206	206	13799	13763

^a Cifras en millones de dólares.

^b Incluye operaciones entre Intermediarios del Mercado Cambiario y otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.